兴科证券投资基金 2006年半年度报告摘要

基金管理人:华夏基金管理有限公司　基金托管人:交通银行股份有限公司

重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2006 年 8 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自 2006 年 1 月 1 日起至 2006 年 6 月 30 日止。本报告中的财务资料未经审计。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

一、基金简介

(一)基金基本情况

基金名称:兴科证券投资基金
基金简称:基金兴科
交易代码:184708
基金运作方式:契约型封闭式
基金合同生效日:2000 年 4 月 8 日
报告期末基金份额总额:500,000,000 份
基金合同存续期:15 年
上市交易所:深圳证券交易所
基金上市日:2000 年 7 月 18 日

(二)基金产品说明

基金投资目标:以新的理念去发掘投资机会,通过积极的投资策略,获取长期的资本增值。

基金投资策略:技术进步,观念更新,21 世纪带来了巨大的变化。本基金投资于那些能适应新时代发展需要的上市公司。

业绩比较基准:无
风险收益特征:无

(三)基金管理人

基金管理人名称:华夏基金管理有限公司
CHINA ASSET MANAGEMENT CO.,LTD.
注册地址:北京市顺义区天竺空港工业区 A 区
办公地址:北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层
邮政编码:100032
法定代表人:凌新源
信息披露负责人:张弘弢
联系电话:(010)88066688
传真:(010)88066566
国际互联网址:www.ChinaAMC.com
电子邮箱:chinaamc@ChinaAMC.com

(四)基金托管人

名称:交通银行股份有限公司(简称"交通银行")
住所:上海市银城中路 188 号
办公地址:上海市银城中路 188 号
邮政编码:200120
法定代表人:蒋超良
信息披露负责人:张咏东
联系电话:(021)68888917
传真:(021)58408836
电子邮箱:zhangyd@bankcomm.com

(五)信息披露

信息披露报纸名称:《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载半年度报告正文的管理人互联网网址:www.ChinaAMC.com
基金半年度报告置备地点:本报告在基金管理人和基金托管人的住所有置备,投资者可要求查阅、复制。

二、主要财务指标和基金净值表现

重要提示:下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(一)主要会计数据和财务指标

主要会计数据和财务指标	2006年1月1日至2006年6月30日
基金本期净收益	216,293,200.49 元
基金份额本期净收益	0.4326 元
期末可供分配基金收益	205,891,439.08 元
期末可供分配基金份额收益	0.4118 元
期末基金资产净值	809,700,556.15 元
期末基金份额净值	1.6194 元
基金加权平均净值收益率	33.21%
本期基金份额净值增长率	54.10%
基金份额累计净值增长率	84.87%

(二)基金净值表现

1、基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.61%	4.32%	-	-	-	-
过去三个月	33.31%	4.83%	-	-	-	-
过去六个月	54.10%	3.55%	-	-	-	-
过去一年	61.49%	2.80%	-	-	-	-
过去三年	69.65%	2.53%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	84.87%	2.16%	-	-	-	-

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况

兴科证券投资基金累计份额净值增长率历史走势图
(2000 年 4 月 8 日至 2006 年 6 月 30 日)

注:1、本基金无业绩比较基准

2、本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%;投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%; 持有一家上市公司的股票, 不得超过基金资产净值的 10%;本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不得超过该证券的 10%;遵守中国证监会规定的其他比例限制。本基金按规定自本基金上市之日起六个月内达到上述规定的投资比例。

3、自 2006 年 2 月 7 日起,聘任王志华先生担任兴科证券投资基金基金经理,张益驰先生不再担任兴科证券投资基金基金经理。

三、管理人报告

(一)基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人及其管理基金的经验

本基金基金管理人为华夏基金管理有限公司。华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日,是经中国证监会批准的首批全国性基金管理公司之一,注册资本 13800 万元。公司总部设在北京,在北京、上海和深圳设有分公司。

截至 2006 年 6 月,公司管理资产规模超过 439 亿元人民币,管理着基金兴华、兴和、兴科、兴安、兴业 5 只封闭式基金,华夏成长、华夏债券、华夏回报、华夏现金增利、华夏大盘精选、华夏红利、上证 50ETF 和中小板 ETF8 只开放式基金,以及亚洲债券基金二期中国子基金和全国社保基金投资组合,是国内管理基金数目最多的基金管理公司,也是管理资产规模最大的基金管理公司之一。

2、基金经理简介

王志华先生,经济学学士。曾任中国宝安集团中南证券深圳证券业务部调研部经理、君安证券公司证券投资部总经理助理。1999 年加入华夏基金管理公司,历任研究员、兴安证券投资基金基金经理、兴科证券投资基金基金经理。现任兴科证券投资基金基金经理。

(二)报告期内基金运作的遵规守信情况的说明

1、基金运作合规性声明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有损害基金持有人利益的行为。

2、内部监察工作报告

报告期内,本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作、保障基金持有人利益出发,由独立于各业务部门的内部监察人员对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查,发现问题及时敦促有关部门整改,并定期制作监察报告报公司管理层。报告期内,本基金管理人内部监察工作重点加强了以下几个方面:

(1) 加强了监察稽核工作力度,颁布实施了合规谈话、稽核记分制等制度。

(2) 通过一线部门预警控制,监察部门定期检查、不定期抽查等工作方法,保证了公司所管理的所有基金合法合规运作,未出现重大违规事件,为公司业务开拓奠定了良好的基础。

(3) 根据监管部门的要求,定期完成季度及年度监察稽核报告,报公司领导及证监会。

(4) 对主要业务部门的制度执行情况进行了稽核。

(5) 组织学习和宣传《证券投资基金管理公司治理准则(试行)》等法规。

(6) 研究开发有关系统,加强公司合规文化宣传。

本报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法,无不当内幕交易和关联交易,保障了基金持有人利益。我们将继续以风险控制为核心,提高内部监察工作的科学性和有效性,切实保障基金安全、合规运作。

(三)报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

1、本基金业绩表现

截至 2006 年 6 月 30 日, 本基金份额净值为 1.6194 元, 本报告期份额净值增长率为 54.10%,同期上证综指上涨 44.02 %,深圳成指上涨 50.22%。

2、行情回顾及运作分析

2006 年上半年市场承接上年年底的股改行情,迅速有效突破上证 1300 点,在多数上市公司业绩快速成长、大股东资产注入等良好预期之下一路上扬,直冲 1700 点,之后受国内宏观调控、银行收紧银根、再融资开闸、外围新兴股市大幅回调、国际商品期货价格调整等多种因素的影响下,大盘才出现调整行情。指数在整体上呈现反复上升的态势,但结构性牛市特点仍然非常突出,其中食品饮料、机械、商业零售板块多数股票单边大幅度上扬,名酒、新能源、军工、装备制造、连锁商业板块尤其突出,牛市预期也大幅推动了与券商有不同相关关系的上市公司的股价,部分汽车股股价由于公司销售数据转好也表现突出,水泥板块由于受到外资购并的推动表现超过指数,其他像大股东资产注入的承诺也带动了相关板块的走强,如军工类企业;区域经济政策的规划也带动了相关上市公司股价大幅走高,如滨海新区部分企业;有色金属板块受国际商品价格大幅上扬一大幅震荡的影响也出现大幅上涨一深幅回调的震荡走势,房地产板块在大幅上涨之后受国家调控政策影响也出现较大幅度的调整,电力、煤炭、钢铁、交通运输等板块表现一般。

宏观经济方面,固定资产投资增长率和银行贷款的增速还维持在高位,国内国际货币领域同时并存着流动性的过剩的现象,同时人民币升值趋势又很明显,因此宏观调控和银根收缩预计仍将会持续一段时间。但是这并不会改变投资者的市场信心。股权分置改革到目前虽然进入一个收尾的阶段,但其作为国内股市一项历史性的制度变迁仍会继续发挥恢复投资者信心、恢复资本市场正常的资源优化配置的作用,国内股市很大一部分上市公司的估值还有待于再提升到一个更为有效、更为合理的水平。

(四)宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年对市场构成压力作用的因素有:宏观调控加强、银根继续收缩、全球中央银行都处在加息的过程中、国内新股发行速度加快、上市公司再融资节奏加快等。尤其在 8 月非流通股集中上市会对若干上市公司的股价有比较大的考验;下半年的有利因素有:市场整体信心还在恢复和逐步强化的过程中, 大盘蓝筹板块相对于其业绩成长而言估值水平较低,这对整体指数构筑了两大强有力的支撑; 同时大股东资产的注入或者整体上市的实现,管理层股权激励的实施等都能导致有关公司业绩的进一步转好。融资融券制度的实施、二级市场收购兼并的可能出现、新股上市给市场带来的更多和更好的资产选择以及超级大盘新股的加入等都会在一定程度上稳定大盘的波动。综上所述,下半年大盘将继续保持强势特征,稳定性更强,波动的空间将减小,决定投资收益水平相对高低的还是组合结构。

投资策略方面,在保持原有较高比例股票仓位的条件下,继续优化股票资产组合;行业方面,继续重点关注金融、零售、品牌消费品、稀缺性资源、房地产等资产性质类行业,以及"十一五"规划中国家重点投资的 3G、数字电视、机床、铁路、造船、航空制造、军工、电力设备、电子元器件、软件、新能源等政府支持类行业;公司方面,继续持有上述行业中自主创新能力强的、自主定价能力强并具备一定品牌优势、管理优势、技术创新优势、市场竞争优势的龙头企业。

基金兴科将继续遵循华夏基金管理有限公司"为信任奉献回报"的宗旨,以持有人利益为第一位,诚实守信,勤奋工作,力争可持续地为投资者获得良好收益。

四、托管人报告

2006 年上半年,托管人在兴科证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

2006 年上半年,华夏基金管理有限公司在兴科证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。基金管理人遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作按照基金合同的规定进行。

2006 年上半年, 由华夏基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关兴科证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

五、财务会计报告

(一)基金会计报表

兴科证券投资基金
2006 年 6 月 30 日资产负债表
(除特别注明外,金额单位为人民币元)

	附注	2006年6月30日	2005年12月31日
资产			
银行存款	7a	2,541,750.97	730,570.12
清算备付金	7b	222,859,463.63	6,359,577.45
交易保证金	7b	637,996.39	631,465.52
应收证券清算款		–	300,588.66
应收股利		397,635.39	–
应收利息	7c	1,912,796.25	2,672,531.90
股票投资市值		587,933,457.89	393,928,982.78
其中:股票投资成本		489,732,229.50	362,488,343.91
债券投资市值		164,334,317.15	125,953,551.40
其中:债券投资成本		160,678,685.43	121,564,432.26
权证投资市值		1,952,256.96	–
其中:权证投资成本		–	–
资产总计		982,569,674.63	530,577,267.83
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		17,728,891.45	2,486,445.74
应付管理人报酬		967,742.02	640,687.12
应付托管费		161,290.32	106,781.19
应付佣金	7d	3,753,330.31	1,299,232.07
应付利息		93,468.00	–
其他应付款	7e	556,125.11	556,125.11
卖出回购证券款		149,400,000.00	–
预提费用	7f	208,271.27	60,000.00
负债合计		172,869,118.48	5,149,271.23
持有人权益			
实收基金	7g	500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得	7h	103,809,117.07	35,829,758.01
未分配收益 /(累计基金净损失)		205,891,439.08	(10,401,761.41)
持有人权益合计		809,700,556.15	525,427,996.60
(2006 年 6 月 30 日每份基金份额净值:1.6194 元)			
(2005 年末每份基金份额净值:1.0509 元)			
负债及持有人权益总计		982,569,674.63	530,577,267.83

兴科证券投资基金
2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日止期间
经营业绩表及收益分配表
(除特别注明外,金额单位为人民币元)

	附注	本期数	上年同期数
收入 /(损失)			
股票差价收入 /(损失)	7i	209,037,202.74	(29,101,868.13)
债券差价收入 /(损失)	7j	(156,783.60)	863,485.25
权证差价收入	7k	6,150,942.15	–
债券利息收入		1,802,251.81	1,579,809.38
存款利息收入		425,124.97	164,357.93
股利收入		5,077,597.13	3,789,728.74
买入返售证券收入		–	–
其他收入	7l	2,362.32	16,616.55
收入 /(损失)合计		222,338,697.52	(22,687,870.28)
费用			
基金管理人报酬		(4,820,177.17)	(3,852,124.69)
基金托管费		(803,362.84)	(642,020.75)
卖出回购证券支出		(200,437.59)	(119,775.00)
利息支出		–	–
其他费用	7m	(221,519.43)	(268,627.43)
其中:上市年费		(29,752.78)	(29,752.78)
信息披露费		(148,765.71)	(145,570.97)
审计费		(29,752.78)	(29,752.78)
费用合计		(6,045,497.03)	(4,882,547.87)
基金净收益 /(损失)		216,293,200.49	(27,570,418.15)
加:未实现利得		67,979,359.06	28,698,661.78
基金经营业绩		284,272,559.55	1,128,243.63
本期基金净收益 /(损失)		216,293,200.49	(27,570,418.15)
加:期初基金净收益 /(累计基金净损失)		(10,401,761.41)	25,957,966.88
可供分配基金净收益		205,891,439.08	(1,612,451.27)
减:本期已分配基金净收益		–	(16,499,924.45)
期末基金净收益 /(累计基金净损失)		205,891,439.08	(18,112,375.72)

兴科证券投资基金
2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日止期间基金净值变动表
(除特别注明外,金额单位为人民币元)

		本期数	上年同期数
期初基金净值		525,427,996.60	516,787,512.68
本期经营活动			
基金净收益 /(损失)		216,293,200.49	(27,570,418.15)
未实现利得		67,979,359.06	28,698,661.78
经营活动产生的基金净值变动数		284,272,559.55	1,128,243.63
本期向基金持有人分配收益			
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数		–	(16,499,924.45)
期末基金净值		809,700,556.15	501,415,831.86

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(二)会计报表附注

(除特别注明外,金额单位为人民币元)

1、主要会计政策和会计估计

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

2、本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

3、重大关联方关系及关联交易

(1)关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
交通银行股份有限公司	基金托管人
西部证券股份有限公司("西部证券")	基金发起人
北京市国有资产经营有限责任公司	基金管理人的股东
西南证券有限责任公司	基金管理人的股东
北京证券有限责任公司("北京证券")	基金管理人的股东
中国科技证券有限责任公司	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2)通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

	2006年1月1日至2006年6月30日							
	买卖股票成交量		买卖债券成交量		债券回购成交量		佣金	
	成交量人民币元	占全年成交量的比例	成交量人民币元	占全年成交量的比例	成交量人民币元	占全年成交量的比例	佣金人民币元	占全年佣金总量的比例
西部证券	238,554,606.98	7.06%	20,227,214.60	20.50%	30,000,000.00	9.09%	196,140.56	7.17%
北京证券	–	–	–	–	–	–	–	–
合计	238,554,606.98	7.06%	20,227,214.60	20.50%	30,000,000.00	9.09%	196,140.56	7.17%

	2005年1月1日至2005年6月30日							
	买卖股票成交量		买卖债券成交量		债券回购成交量		佣金	
	成交量人民币元	占全年成交量的比例	成交量人民币元	占全年成交量的比例	成交量人民币元	占全年成交量的比例	佣金人民币元	占全年佣金总量的比例
西部证券	73,358,725.34	7.06%	8,116,560.00	17.60%	–	–	60,113.81	7.16%
北京证券	118,888,728.94	11.42%	1,916,200.00	4.15%	–	–	93,031.43	11.08%
合计	192,247,454.28	18.47%	10,032,760.00	21.75%	–	–	153,145.24	18.24%

上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取,并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(3)基金管理人报酬

支付基金管理人华夏基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

本基金在本报告期需支付基金管理人报酬 4,820,177.17 元 (上年同期:3,852,124.69 元)。

(4)基金托管费

支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

本基金在本报告期需支付基金托管费 803,362.84 元(上年同期:642,020.75 元)。

(5)由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2006 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 2,541,750.97 元 (2005 年 6 月 30 日:1,011,275.90 元)。本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 41,136.42 元(上年同期:74,372.71 元)。

(6)与关联方通过银行间同业市场进行的债券(含回购)交易

本报告期与上年同期未与关联方进行银行间市场的债券(含回购)交易。

(7)本基金管理人、关联方及关联方主要股东的控制机构持有的基金份额

	2006年6月30日			
	基金份额数(份)	占基金总份额比	本期买入份额(份)	本期卖出份额(份)
华夏基金管理有限公司	34,976,253	7.00%	32,476,253	–
合计	34,976,253	7.00%	32,476,253	–
	2006年6月30日			
	基金份额数(份)	占基金总份额比	本期买入份额(份)	本期卖出份额(份)
华夏基金管理有限公司	2,500,000	0.50%	–	–
西部证券股份有限公司	4,156,683	0.83%	–	–
合计	6,656,683	1.33%	–	–

本基金适用费率为 0%。

4、流通受限制不能自由转让的基金资产

流通受限制不能自由转让的股票

本基金截至 2006 年 6 月 30 日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票,这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

股票代码	股票名称	停牌日期	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末估值总额
方案沟通协商阶段停牌							
600415	小商品城	2006-06-19	62.24	2006-07-04	57.05	390,643	24,313,620.32
方案实施阶段停牌							
600641	中远发展	2006-04-05	5.77	2006-07-26	6.23	899,958	5,192,757.66
600970	中材国际	2006-06-16	27.15	2006-07-06	23.80	674,060	18,300,729.00
000895	双汇发展	2006-06-01	31.02	-	-	1,061,700	32,933,934.00
合 计						3,026,361	80,741,040.98

根据中国证券监督管理委员会的政策规定,2000 年 5 月 18 日起新股发行时不再单独向基金配售新股。基金可比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股, 根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让; 基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

此外,根据中国证券监督管理委员会证监发行字[2002]54 号文《关于向二级市场投资者配售新股有关问题的补充通知》及其配套规定,自 2002 年 5 月 20 日起,恢复向二级市场投资者配售新股。基金以持有的上市流通股票市值参与配售,但累计申购总额不得超过基金按规定可申购的总额。获配新股从新股获配日至新股上市日之间不能自由流通。

本基金截至 2006 年 6 月 30 日止持有的因获配新股流通受限制股票情况如下:

股票名称	成功申购日期	上市日期	可流通日期	申购价格	期末估价	成功申购股数	成本	市值	占净值比
公开发行股票									
大同煤业	2006-06-12	2006-06-23	2006-09-25	6.76	10.27	105,809	715,268.84	1,086,658.43	0.13%
中国银行	2006-06-28	2006-07-05	2006-07-05	3.08	3.08	1,395,000	4,296,600.00	4,296,600.00	0.53%
中国银行	2006-06-28	2006-07-05	2006-10-05	3.08	3.08	1,487,805	4,582,439.40	4,582,439.40	0.57%
中国银行	2006-06-28	2006-07-05	2007-01-05	3.08	3.08	1,487,804	4,582,436.32	4,582,436.32	0.57%
中工国际	2006-06-02	2006-06-19	2006-09-19	7.40	17.62	116,373	861,160.20	2,050,492.26	0.25%
同洲电子	2006-06-09	2006-06-27	2006-09-27	16.00	40.77	34,423	550,768.00	1,403,425.71	0.17%
云南盐化	2006-06-12	2006-06-27	2006-09-27	7.30	13.32	123,208	899,418.40	1,641,130.56	0.20%
合计							16,488,091.16	19,643,182.68	2.43%

六、投资组合报告

(一)报告期末基金资产组合情况

	金额(元)	占基金总资产比例
股票	587,933,457.89	59.84%
债券	164,334,317.15	16.72%
权证	1,952,256.96	0.20%
资产支持证券	–	–
银行存款和清算备付金合计	225,401,214.60	22.94%
其他资产	2,948,428.03	0.30%
合计	982,569,674.63	100.00%

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	股票市值(元)	市值占基金资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采掘业	1,086,658.43	0.13%
C	制造业	300,040,263.02	37.06%
C0	其中:食品、饮料	133,786,256.99	16.52%
C1	纺织、服装、皮毛	–	–
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	–	–
C5	电子	27,951,595.16	3.45%
C6	金属、非金属	96,373,166.64	11.90%
C7	机械、设备、仪表	41,929,244.23	5.18%
C8	医药、生物制品	–	–
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	18,300,729.00	2.26%
F	交通运输、仓储业	65,943,314.53	8.14%
G	信息技术业	43,455,087.62	5.37%
H	批发和零售贸易	46,279,837.31	5.72%
I	金融、保险业	52,261,281.72	6.45%
J	房地产业	5,192,757.66	0.64%
K	社会服务业	5,880,385.02	0.73%
L	传播与文化产业	25,179,523.26	3.11%
M	综合类	24,313,620.32	3.00%
	合计	587,933,457.89	72.61%

(三)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	占净值比例
1	600036	G 招 行	4,999,975	38,799,806.00	4.79%
2	600519	G 茅 台	799,859	37,945,310.96	4.69%
3	600694	大商股份	892,994	36,443,085.14	4.50%
4	000895	双汇发展	1,061,700	32,933,934.00	4.07%
5	000858	G 五粮液	2,199,970	32,405,558.10	4.00%
6	000039	G 中 集	1,946,616	31,476,780.72	3.89%
7	600009	G 沪机场	1,999,979	28,699,698.65	3.54%
8	600415	小商品城	390,643	24,313,620.32	3.00%
9	600269	G 赣 粤	2,199,808	21,558,118.40	2.66%
10	600183	G 生 益	1,799,827	19,924,084.89	2.46%

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站 www.ChinaAMC.com 的半年度报告正文。

(四)报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600036	G 招 行	59,738,566.41	11.37%
2	000002	G 万科 A	46,237,281.70	8.80%
3	600050	G 联 通	39,369,016.98	7.49%
4	000063	G 中 兴	39,339,420.47	7.49%
5	600009	G 沪机场	39,108,464.20	7.44%
6	600037	G 歌 华	38,941,952.75	7.41%
7	600183	G 生 益	35,545,477.32	6.77%
8	600519	G 茅 台	33,827,068.20	6.44%
9	600550	G 天 威	33,720,734.13	6.42%
10	000898	G 鞍 钢	31,766,373.91	6.05%
11	002024	苏宁电器	29,653,747.82	5.64%
12	600331	G 宏 达	28,955,987.61	5.51%
13	600887	G 伊 利	28,413,516.22	5.41%
14	000039	G 中 集	27,857,707.70	5.30%
15	600016	G 民 生	27,321,432.96	5.20%
16	600309	G 万 华	27,011,014.73	5.14%
17	000858	G 五粮液	26,834,811.06	5.11%
18	600028	中国石化	26,360,758.11	5.02%
19	600030	G 中 信	25,539,084.12	4.86%
20	600717	G 天津港	25,332,508.73	4.82%
21	600316	洪都航空	24,414,959.34	4.65%
22	000970	G 三 环	23,705,509.02	4.51%
23	600832	G 明 珠	22,629,625.00	4.31%
24	000709	G 唐 钢	22,218,795.12	4.23%
25	600019	G 宝 钢	22,126,260.46	4.21%
26	000825	G 太 钢	21,883,116.72	4.16%
27	600001	G 邯 钢	21,739,578.75	4.14%
28	600269	G 赣 粤	21,406,663.10	4.07%
29	000768	G 西 飞	20,937,886.89	3.98%
30	600151	G 航 天	20,829,549.55	3.96%
31	000900	G 现投股	20,708,729.53	3.94%
32	600582	天地科技	20,451,931.09	3.89%
33	000060	G 中 金	20,032,000.36	3.81%
34	000997	G 新大陆	19,830,993.45	3.77%
35	600362	G 江 铜	19,196,444.72	3.65%
36	002025	航天电器	17,896,703.72	3.41%
37	600489	G 中黄金	17,462,032.49	3.32%
38	600415	小商品城	17,388,029.81	3.31%
39	000061	G 农产品	17,277,630.87	3.29%
40	000895	双汇发展	17,276,967.10	3.29%
41	000878	G 云 铜	16,572,685.83	3.15%
42	000088	G 盐田港	16,217,277.68	3.09%
43	000630	G 铜 都	16,131,361.29	3.07%
44	600831	G 广 电	15,848,884.52	3.02%
45	600879	G 火 箭	15,812,356.72	3.01%
46	000792	G 钾 肥	15,780,987.24	3.00%
47	600880	G 博 瑞	15,341,139.41	2.92%
48	600970	中材国际	14,610,124.51	2.78%
49	600010	G 包 钢	14,408,705.18	2.74%
50	600472	G 包 铝	13,944,017.72	2.65%
51	601988	中国银行	13,461,475.72	2.56%
52	000839	G 国 安	13,066,553.28	2.49%
53	600332	G 广 药	12,670,288.11	2.41%
54	000538	G 云白药	12,589,050.95	2.40%
55	000869	G 张 裕	12,008,411.34	2.29%
56	600102	莱钢股份	11,577,780.15	2.20%
57	000927	一汽夏利	11,099,937.60	2.11%
58	600360	G 华 微	10,804,689.47	2.06%

2、报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	000002	G 万科 A	58,149,531.59	11.07%
2	600316	洪都航空	48,795,092.42	9.29%
3	600028	中国石化	48,174,119.42	9.17%
4	000063	G 中 兴	46,352,105.15	8.82%
5	000970	G 三 环	44,589,752.98	8.49%
6	600016	G 民 生	41,949,170.91	7.98%
7	600037	G 歌 华	41,232,491.90	7.85%
8	002024	苏宁电器	40,017,270.07	7.62%
9	600030	G 中 信	38,506,246.46	7.33%
10	600050	G 联 通	38,392,027.94	7.31%
11	600879	G 火 箭	35,956,812.75	6.84%
12	600151	G 航 天	35,393,604.95	6.74%
13	000792	G 钾 肥	34,952,421.10	6.65%
14	600456	G 宝 钛	34,671,680.90	6.60%
15	600550	G 天 威	32,632,940.12	6.21%
16	600887	G 伊 利	29,624,077.58	5.64%
17	600009	G 沪机场	27,597,313.64	5.25%
18	600036	G 招 行	26,833,842.69	5.11%
19	600331	G 宏 达	26,806,481.97	5.10%
20	600309	G 万 华	26,367,197.23	5.02%
21	000402	G 金融街	25,406,955.77	4.84%
22	000898	G 鞍 钢	24,364,284.46	4.64%
23	000060	G 中 金	22,491,411.71	4.28%
24